

**Fecha de Publicación: 5 de febrero de 2016**

**Fecha de Información: 03 de febrero de miércoles <sup>1</sup>**

### **INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1302.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	293.6	121.6	46.0	191.0	7.6	34.7	68.0
15-35	459.1	489.8	335.3	176.8	24.6	152.3	130.0
36-60	3.5	18.0	0.0	0.0	18.0	3.5	0.0
61-90	6.6	32.5	30.0	0.0	2.5	6.6	0.0
91-180	15.7	7.0	0.0	13.0	7.0	2.7	0.0
>180	4.5	48.7	46.0	0.0	2.7	4.5	0.0
<b>Total</b>	<b>782.9</b>	<b>717.7</b>	<b>457.3</b>	<b>380.7</b>	<b>62.4</b>	<b>204.2</b>	<b>198.0</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### **Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada**

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.8 %	4.9 %	3.7 %	4.1 %
15-35	4.5 %	5.8 %	4.2 %	4.9 %
36-60	-	5.2 %	4.2 %	5.0 %
61-90	-	5.1 %	4.3 %	5.0 %
91-180	-	5.3 %	4.7 %	5.1 %
>180	-	5.2 %	4.7 %	5.2 %
<b>Total</b>	<b>4.6 %</b>	<b>5.6 %</b>	<b>4.0 %</b>	<b>4.7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	1 al 5 de febrero				8 al 12 de febrero				15 al 19 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	93	3311	2851	40	93	2403	2113	12	96	2317	2603
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1689	1433	0	0	1097	591	0	0	1531	633
<b>Otros</b>	93	20	497	1212	93	40	734	1530	96	12	603	1215
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5496</b>	<b>5496</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>4235</b>	<b>4235</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4451</b>	<b>4451</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.